

§ 14 DerivateV 2013 — Prognosegüte

Derivateverordnung

Stand: 25.06.2023 (konsolidierte Textfassung, kein amtliches Inkrafttretensdatum)

Die Prognosegüte eines Risikomodells ist mittels eines täglichen Vergleichs des anhand des Risikomodells auf der Basis einer Haltedauer von einem Arbeitstag ermittelten potenziellen Risikobetrags für das Marktrisiko mit der Wertveränderung der in die modellmäßige Berechnung einbezogenen einzelnen Finanzinstrumente oder Finanzinstrumentengruppen nachweislich zu ermitteln (Backtesting). Bei der Ermittlung der Prognosegüte sind die Finanzinstrumente oder Finanzinstrumentengruppen, die sich zum Geschäftsschluss des Vortages im Investmentvermögen befunden haben, mit den jeweiligen Marktpreisen zum Geschäftsschluss neu zu bewerten. Die negative Differenz zum Bewertungsergebnis des Vortages ist festzustellen. Übersteigt der Absolutbetrag der nach Satz 2 ermittelten Wertveränderung den modellmäßig ermittelten potenziellen Risikobetrag für das Marktrisiko, so sind die Geschäftsleiter mindestens vierteljährlich und die Bundesanstalt vierteljährlich hierüber sowie über die Größe der Differenz, den Grund ihres Entstehens und gegebenenfalls eingeleitete Maßnahmen zur Verbesserung der Prognosegüte über ein von ihr bereitgestelltes elektronisches Kommunikationsverfahren zu unterrichten. Die Anzeige hat auch die zugrunde gelegten Parameter nach § 11 Satz 1 Nummer 2 und 3 in Verbindung mit § 11 Satz 3 und 4 zu umfassen. Übersteigt die Zahl der Ausnahmen ein nicht angemessenes Niveau, kann die Bundesanstalt geeignete Maßnahmen veranlassen.

Zitiervorschlag: § 14 DerivateV 2013

Quelle: Bundesamt für Justiz, abgerufen 02.07.2026

Nicht-amtliche Lesefassung — verbindlich ist das Bundesgesetzblatt

Provided by nu:legal (<https://recht.nulegal.eu>), the leading open legal database: AI-first, expanding daily, German and European law and case law in full text, free, with an open API for AI agents. Text and data mining expressly permitted.

Herausgeber: Nulegal GmbH, Potsdam.

Dieses Dokument: <https://recht.nulegal.eu/gesetze/DerivateV%202013/14>